

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 13 de septiembre de 2022**

**Fecha de Información: 09 de septiembre de 2022<sup>1</sup>**

Según el reporte de los Sistemas de Información y Registro de Operaciones sobre Divisas del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$3479 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.42%<sup>2</sup>.

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados<sup>a</sup>

Rango	Sector Financiero <sup>b</sup>		Intragruppo y Off-shore <sup>c</sup>		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	920,4	1165,3	335,1	423,7	357,2	23,7	473,0
15-35	945,1	1058,8	457,7	295,4	70,0	0,0	649,7
36-60	2,3	25,5	0,0	0,0	25,5	2,3	0,0
61-90	189,8	87,9	32,6	0,0	30,4	164,8	25,0
91-180	116,2	99,3	22,0	80,0	42,3	1,2	35,0
>180	31,4	38,1	10,0	6,5	9,1	5,9	19,0
<b>Total</b>	<b>2205,2</b>	<b>2475,1</b>	<b>857,4</b>	<b>805,6</b>	<b>534,5</b>	<b>197,9</b>	<b>1201,7</b>

<sup>a</sup> Cifras en millones de dólares

<sup>b</sup> Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y operaciones con los otros agentes

<sup>c</sup> Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior

Cuadro No. 2 Devaluación Implícita Ponderada por monto Anualizada

Rango	Intermediarios del Mercado Cambiario <sup>a</sup>	Otros Agentes sin intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	6.76%	5.44%	5.51%	5.93%
15-35	6.76%	6.46%	6.74%	6.64%
36-60	—	7.16%	6.92%	7.14%
61-90	7.06%	6.94%	6.86%	6.89%
91-180	7.42%	7.60%	7.48%	7.52%
>180	7.61%	7.79%	7.66%	7.66%
<b>Total</b>	<b>6.80%</b>	<b>6.12%</b>	<b>6.37%</b>	<b>6.42%</b>

<sup>a</sup> Incluye solo operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

<sup>1</sup> A partir del 7 de diciembre se calcula este reporte incorporando la información preliminar reportada por los Sistemas de Información y Registro de Operaciones sobre divisas al Banco de la República.

<sup>2</sup> El monto negociado diario corresponde a las operaciones de compra y venta evitando la doble contabilización de las operaciones interbancarias. Además, la fórmula para la devaluación implícita es:  $((\text{Tasa Pactada} / \text{Tasa de Contado}) ^ {(365 / \text{Plazo})}) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

“Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	05 – 09 sep.				12 - 16 sep.				19 - 23 sep.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	7	39	576	644	64	210	6588	8318	18	188	8352	8286
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	402	400	1	0	3076	2420	0	0	4205	3619
Otros <sup>c</sup>	39	7	165	92	209	64	2569	1199	188	18	1242	1858
<b>Total</b>	<b>46</b>	<b>46</b>	<b>1143</b>	<b>1136</b>	<b>274</b>	<b>274</b>	<b>12233</b>	<b>11937</b>	<b>206</b>	<b>206</b>	<b>13799</b>	<b>13763</b>

<sup>a</sup> Cifras en millones de dólares.

<sup>b</sup> Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y otros agentes

<sup>c</sup> Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.